

浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人浙江浙商证券资产管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

浙江浙商证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	20
6.4	报表附注	22
§ 7	投资组合报告	46
7.1	期末基金资产组合情况	46
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12	本报告期投资基金情况	49
7.13	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	53

8.2 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.9 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）	
基金主代码	013781	
基金运作方式	契约型、开放式；本基金B类基金份额每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置一年的最短持有期限；本基金A类基金份额以定期开放方式运作，以三个月为一个封闭期，其进入开放期仅开放赎回，不开放申购。	
基金合同生效日	2021年11月08日	
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	54,287,077.96份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B
下属分级基金的交易代码	013781	013782
报告期末下属分级基金的份额总额	35,634,721.35份	18,652,356.61份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，通过主动大类资产配置，优选基金投资组合，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的大类资产配置策略通过宏观基本面分析进行确定，同时随着市场环境变化、政策变化引入战术资产配置对组合进行适时调整。（一）大类资产配置策略；（二）基金筛选策略；（三）股票投资策略；（四）债券投资策略；（五）资产支持证券投资策略；（六）其他。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数（总

	值）收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），一般情况下，其长期风险收益特征高于债券型基金中基金（FOF）、债券型基金、货币型基金中基金（FOF）及货币市场基金，但低于股票型基金中基金（FOF）和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浙江浙商证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨锴	任航
	联系电话	0571-87903297	010-66060069
	电子邮箱	fund@stocke.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95345	95599
传真		0571-87902581	010-68121816
注册地址		浙江省杭州市拱墅区天水巷25号	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		310020	100031
法定代表人		盛建龙	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.stocke.com.cn
基金中期报告置备地点	浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼7楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
--------	----------------	----------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	浙商汇金卓越配置 一年持有混合（FOF）A	浙商汇金卓越配置 一年持有混合（FOF）B
本期已实现收益	3,412,565.56	1,847,758.06
本期利润	8,554,070.82	4,667,828.15
加权平均基金份额本期利润	0.2130	0.2223
本期加权平均净值利润率	10.01%	10.36%
本期基金份额净值增长率	11.10%	11.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	46,092,837.25	24,468,309.56
期末可供分配基金份额利润	1.2935	1.3118
期末基金资产净值	81,727,558.60	43,120,666.17
期末基金份额净值	2.2935	2.3118
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-13.69%	-13.00%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金T日的基金份额净值在所投资基金披露净值的当日（法定节假日顺延至第一个交易日）计算，并于T+2日公告。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.28%	0.96%	6.52%	0.63%	6.76%	0.33%
过去六个月	11.10%	0.86%	4.92%	0.57%	6.18%	0.29%
过去一年	21.71%	0.68%	13.59%	0.51%	8.12%	0.17%
过去三年	6.82%	1.00%	22.38%	0.55%	-15.56%	0.45%
自基金合同 生效起至今	-13.69%	0.94%	13.63%	0.55%	-27.32%	0.39%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%。

其中，沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证券交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照50%、50%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④

过去三个月	13.13%	0.97%	6.52%	0.63%	6.61%	0.34%
过去六个月	11.01%	0.86%	4.92%	0.57%	6.09%	0.29%
过去一年	21.74%	0.68%	13.59%	0.51%	8.15%	0.17%
过去三年	7.39%	1.00%	22.38%	0.55%	-14.99%	0.45%
自基金合同生效起至今	-13.00%	0.94%	13.63%	0.55%	-26.63%	0.39%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%。

其中，沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

中债总财富指数（总值）收益率由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，其指数样本涵盖上海证券交易所、深圳证券交易所以及银行间市场的各类券种，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够反映本基金的风险收益特征。本基金业绩基准指数每日按照50%、50%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月08日-2026年06月30日)



浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月08日-2026年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浙江浙商证券资产管理有限公司成立于2013年4月18日，是原浙商证券有限责任公司设立的全资子公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准浙商证券有限责任公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可（2012）1431号）批准，由浙商证券股

份有限公司出资12亿元从事资产管理业务。2014年8月19日中国证券监督管理委员会批准《关于核准浙江浙商证券资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可（2014）857号）。

公司主要经营范围涉及证券资产管理业务和公开募集证券投资基金管理业务。截止2026年6月30日，本基金管理人管理浙商汇金转型成长混合型证券投资基金、浙商汇金转型驱动灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚利一年定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金鼎盈事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、浙商汇金短债债券型证券投资基金、浙商汇金量化精选灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金中高等级三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商汇金聚盈中短债债券型证券投资基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金、浙商汇金中证浙江凤凰行动50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浙商汇金新兴消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金聚泓两年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金安享66个月定期开放债券型证券投资基金、浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金、浙商汇金量化臻选股票型证券投资基金、浙商汇金先进制造混合型证券投资基金、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)、浙商汇金月享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金兴利增强债券型证券投资基金、浙商汇金双月鑫60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浙商汇金金算盘货币市场基金、浙商汇金聚瑞债券型证券投资基金、浙商汇金平稳增长一年持有期混合型基金中基金、浙商汇金聚兴一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商汇金卓越稳健3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、浙商汇金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、浙商汇金中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、浙商汇金聚悦利率债债券型证券投资基金、浙商汇金红利精选混合型发起式证券投资基金、浙商汇金红利机遇混合型证券投资基金、浙商汇金聚沣30天持有期高等级债券型证券投资基金、浙商汇金中证A500指数型证券投资基金、浙商汇金锦利增强30天持有期债券型证券投资基金和浙商汇金上证科创板综合指数型证券投资基金等36只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋青涛	资产配置部总经理	2021-11-08	2026-02-06	16年	中国国籍，金融硕士，历任

	助理				浙商证券研究所电子行业研究员、浙商证券自营业务股票和债券投资经理、浙商证券资产管理有限公司大宗商品和行业公司研究员、浙商汇金卓越优选3个月持有期股票型基金中基金（FOF）基金经理，浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浙商汇金卓越稳健3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理。现任资产配置部总经理助理。拥有基金从业资格及证券从业资格。
陈正声	本基金基金经理，资产配置部行政负责人，浙商汇金卓越稳健3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金经理。	2026-01-27	-	9年	复旦大学应用经济学博士后，大连理工大学金融工程博士。9年证券从业年限，曾任上海申银万国证券研究所金融工程部博士后研究员、申万宏源证券资产管理事业部权益投资部FOF投资负责人、山西证券金融产品投资部总经理，现任浙江浙商证券资产管理有限公司资产配置部行政负责人。自2026年1月27日起任浙商汇金卓越稳健3个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理。具备基金从业资格及证券从业资格。

					格。
--	--	--	--	--	----

- 1、上述表格内基金经理的任职日期、离职日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。对基金的首任基金经理，其"任职日期"按基金合同生效日填写。
- 2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。
- 3、2026年2月6日，宋青涛不再任职本基金的基金经理，并已按相关规定备案、公告。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金基金经理未存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、其他相关法律法规和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《浙江浙商证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股是"指数结构性上涨+个股结构性下跌"的极致分化牛市--科技（尤其 AI 硬件产业链）是全市场唯一的资金蓄水池，创造了半导体 +105%、覆铜板 +220% 的爆发行情，但代价是超六成股票下跌、中位数 -14%。上证靠权重护盘勉强收正 (+3.16%)，

科创 50 (+64%) 与创业板 (+35.6%) 一骑绝尘；消费、地产、大盘价值、小微盘等板块集体承压。

本基金上半年以来在市场波动中坚守因子投资和景气投资的理念，于成长与价值风格间适度配置，整体偏向进攻。上半年整体上小盘成长风格占优，价值风格阶段性偏弱。在景气投资视角下，我们的产品组合适度配置了高景气行业，整体上偏向进攻性的成长，目标是在承受一定波动的情况下，实现客户收益最大化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A 基金份额净值为 2.2935 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 11.10%，同期业绩比较基准收益率为 4.92%；截至报告期末浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B 基金份额净值为 2.3118 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 11.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突、贸易政策反复及主要经济体货币政策分化影响下延续低速修复，外部不确定性仍然较高。国内稳增长政策持续发力，经济运行总体平稳，上半年国内生产总值同比增长 4.7%，但内需恢复仍显不足，房地产投资和居民消费信心偏弱，出口及高技术制造业、数字经济等新动能表现相对较强，经济结构分化特征较为明显。证券市场方面，A 股整体震荡上行但风格分化显著，人工智能、半导体、高端制造等科技成长板块表现突出，传统红利及部分消费板块相对承压；债券市场在货币环境保持合理充裕、经济温和修复的背景下总体保持平稳，中高等级信用债具有一定票息配置价值，但随着收益率处于相对低位，债券资产的资本利得空间有所收窄，市场对于久期管理和信用风险识别提出了更高要求。

展望下半年，国内宏观政策有望继续保持积极取向，财政政策将更加注重稳投资、促消费和培育新质生产力，货币政策预计维持适度宽松，经济有望延续温和修复，但外需变化、地产调整及地缘政治仍可能扰动市场。权益市场估值与流动性环境相对友好，结构性机会仍将占主导，科技创新、先进制造、消费复苏及高股息资产均具备阶段性配置价值，但需警惕前期涨幅较大板块的估值波动。债券市场预计以震荡为主，票息收益仍具基础配置价值，久期策略需更加灵活。

基金配置层面，管理人将继续坚持多资产、多策略和风格均衡，通过动态调整权益、债券及商品类资产比例，精选具备稳定超额收益能力的基金产品，努力提升组合的风险收益比。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定及我司估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取现金分红方式的，在该红利发放之日起7个工作日内，将现金红利扣除基金管理人应提业绩报酬（如有）后划转到基金份额持有人的基金交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除基金管理人应提业绩报酬（如有）后按分红除息日各类基金份额的单位净值转成相应的基金份额；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金各类基金份额收取管理费不同，各类基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运行情况，本基金未对报告期内利润进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未发生《公开募集证券投资基金运行管理办法》的第四十一条所述情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,974,167.02	15,523,565.58
结算备付金		44,700.36	407,088.22
存出保证金		35,815.45	117,009.95
交易性金融资产	6.4.7.2	114,880,599.28	115,911,648.28
其中：股票投资		-	4,270,176.00
基金投资		114,880,599.28	111,641,472.28
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		321,584.26	3,490,288.03
应收股利		-	38,651.68
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		126,256,866.37	135,488,251.74
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		199,444.96	-
应付赎回款		541,208.11	101,215.34
应付管理人报酬		75,367.26	82,501.75
应付托管费		20,522.70	22,850.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		482,988.84	152,904.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	89,109.73	172,641.44
负债合计		1,408,641.60	532,113.24
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	54,287,077.96	65,168,657.77
未分配利润	6.4.7.8	70,561,146.81	69,787,480.73
净资产合计		124,848,224.77	134,956,138.50
负债和净资产总计		126,256,866.37	135,488,251.74

注：报告截止日2026年6月30日，浙商汇金卓越配置一年持有混合(FOF)A份额净值(暂估业绩报酬前)人民币2.2935元，基金份额总额35,634,721.35份，未计提暂估业绩报酬；浙商汇金卓越配置一年持有混合(FOF)B份额净值(暂估业绩报酬前)人民币2.3118元，基金份额总额18,652,356.61份，暂估业绩报酬金额人民币0.17元；总份额合计54,287,077.96份，基金资产净值(暂估业绩报酬后)人民币124,848,224.60元。

其中，暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(暂估业绩报酬前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬，该金额是各基金份额持有人的暂估业绩报酬的合计，各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，与暂估业绩报酬可能存在差异。

6.2 利润表

会计主体：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		13,927,033.63	-1,060.17
1.利息收入		20,794.91	27,560.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,794.91	26,858.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	702.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,944,622.57	-6,756,167.73

其中：股票投资收益	6.4.7.10	761,913.80	-879,635.29
基金投资收益	6.4.7.11	4,626,263.93	-6,059,691.46
债券投资收益	6.4.7.12	-	156,459.02
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	556,444.84	26,700.00
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	7,961,575.35	6,727,534.05
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	40.80	12.92
减：二、营业总支出		705,134.66	765,026.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	473,098.87	533,060.16
2.托管费	6.4.10.2.2	127,148.50	144,094.54
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		17,175.71	355.27
8.其他费用	6.4.7.21	87,711.58	87,516.10
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		13,221,898.97	-766,086.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		13,221,898.97	-766,086.24

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,221,898.97	-766,086.24

6.3 净资产变动表

会计主体：浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	65,168,657.77	69,787,480.73	134,956,138.50
二、本期期初净资产	65,168,657.77	69,787,480.73	134,956,138.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,881,579.81	773,666.08	-10,107,913.73
（一）、综合收益总额	-	13,221,898.97	13,221,898.97
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-10,881,579.81	-12,448,232.89	-23,329,812.70
其中：1.基金申购款	16,985.53	18,675.40	35,660.93
2.基金赎回款	-10,898,565.34	-12,466,908.29	-23,365,473.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	54,287,077.96	70,561,146.81	124,848,224.77
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	84,981,776.60	76,508,861.00	161,490,637.60
二、本期期初净资产	84,981,776.60	76,508,861.00	161,490,637.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,664,742.82	-7,664,912.14	-15,329,654.96
（一）、综合收益总额	-	-766,086.24	-766,086.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-7,664,742.82	-6,898,825.90	-14,563,568.72
其中：1.基金申购款	34,159.09	30,064.92	64,224.01
2.基金赎回款	-7,698,901.91	-6,928,890.82	-14,627,792.73
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	77,317,033.78	68,843,948.86	146,160,982.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

盛建龙

盛建龙

徐海锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）是由浙商汇金1号集合资产管理计划变更注册而来。根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予浙商汇金1号集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]2904号）及本基金的管理人浙江浙商证券资产管理有限公司于2021年11月8日发布的《关于浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）及基金合同生效公告》，自2021年11月8日起，《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，《浙商汇金1号集合资产管理合同》同时失效，浙商汇金1号集合资产管理计划正式变更为浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）。本基金以契约型开放式的方式运作，基金存续期限不定。本基金的基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括QDII基金和香港互认基金）的基金份额、国内依法公开发行上市交易的股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（国债、金融债券、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中债总财富指数（总值）收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、2026年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、

财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入,自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起,对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d)本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	10,974,167.02

等于：本金	10,973,060.85
加：应计利息	1,106.17
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,974,167.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		101,960,141.96	-	114,880,599.28	12,920,457.32
其他		-	-	-	-
合计		101,960,141.96	-	114,880,599.28	12,920,457.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末，未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金在本报告期末，未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末，未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金在本报告期末，未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,758.45
其中：交易所市场	10,758.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,351.28
合计	89,109.73

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
----------------------	-------------------------------

混合（FOF）A	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,839,117.76	41,839,117.76
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,204,396.41	-6,204,396.41
本期末	35,634,721.35	35,634,721.35

6.4.7.7.2 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

金额单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,329,540.01	23,329,540.01
本期申购	16,985.53	16,985.53
本期赎回（以“-”号填列）	-4,694,168.93	-4,694,168.93
本期末	18,652,356.61	18,652,356.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,653,107.12	-11,118,688.84	44,534,418.28
本期期初	55,653,107.12	-11,118,688.84	44,534,418.28
本期利润	3,412,565.56	5,141,505.26	8,554,070.82
本期基金份额交易产生的变动数	-8,540,340.86	1,544,689.01	-6,995,651.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-8,540,340.86	1,544,689.01	-6,995,651.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,525,331.82	-4,432,494.57	46,092,837.25

6.4.7.8.2 浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B

单位：人民币元

项目 (浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,667,724.78	-6,414,662.33	25,253,062.45
本期期初	31,667,724.78	-6,414,662.33	25,253,062.45
本期利润	1,847,758.06	2,820,070.09	4,667,828.15
本期基金份额交易产生的变动数	-6,513,573.93	1,060,992.89	-5,452,581.04
其中：基金申购款	23,324.25	-4,648.85	18,675.40
基金赎回款	-6,536,898.18	1,065,641.74	-5,471,256.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,001,908.91	-2,533,599.35	24,468,309.56

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	20,458.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	199.84
其他	136.28
合计	20,794.91

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
----	-------------------------------

卖出股票成交总额	6,292,076.33
减：卖出股票成本总额	5,523,190.47
减：交易费用	6,972.06
买卖股票差价收入	761,913.80

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	153,438,329.99
减：卖出/赎回基金成本总额	148,524,162.07
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	143,131.11
减：交易费用	144,772.88
基金投资收益	4,626,263.93

6.4.7.12 债券投资收益

本基金在本报告期内，未持有债券。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内，未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内，未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内，未持有衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内，未持有其他衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	556,444.84
合计	556,444.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	8,233,642.84
——股票投资	-106,521.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	8,340,164.02
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	272,067.49
合计	7,961,575.35

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	40.80
合计	40.80

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	42,485.55
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	360,457.64
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	68,878.55

注：1、当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

2、根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金在本报告期内，未产生信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,492.50
账户维护费	4,867.80
合计	87,711.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化，以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浙江浙商证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、本基金销售机构
浙商证券股份有限公司	基金管理人的母公司、本基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
浙商证券股份有限公司	5,173,508.98	67.61%	60,517,013.31	67.22%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
浙商证券 股份有限 公司	-	-	5,790,000.00	100.00%

注：本基金在本报告期内，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
浙商证券 股份有限 公司	103,686,603.59	82.52%	429,768,307.79	78.74%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	2,255.13	67.61%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
浙商证券股份有限公司	26,381.80	67.22%	4,894.01	5.69%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	473,098.87	533,060.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	231,445.45	263,938.51
应支付基金管理人的净管理费	241,653.42	269,121.65

注：1、基金管理人的固定管理费

（1）不同类别份额的固定管理费分别计算，从相应类别份额的资产净值计提。

A类基金份额0.8%/年；B类基金份额0.6%/年

（2）固定管理费计算

本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取固定管理费。本基金的固定管理费按前一日该类基金资产净值扣除前一日该类基金份额按比例所持有本基金管理人管理的其他基金部分所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）的该类基金份额相应固定管理费年费率计提。基金固定管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{该类基金份额固定管理费年费率} \div \text{当年天数}$

H为该类基金份额每日应计提的固定管理费，E为前一日的该类基金份额基金资产净值扣除前一日该类基金份额按比例所持有的本基金管理人管理的其他基金部分所对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0。

（3）固定管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金管理人的业绩报酬

（1）A类基金份额业绩报酬

①A类基金份额业绩报酬计提日为本基金分红日、原浙商汇金1号集合资产管理计划成立之日起每满三个月的最后一个交易日。

②在A类基金份额业绩报酬计提日，对于A类基金份额累计净值（计提业绩报酬之前）高于之前各业绩报酬计提日单位累计净值（包括原浙商汇金1号集合资产管理计划存续期限内）的最高值，且高于1.10元时，基金管理人将对于A类基金份额提取业绩报酬，提取比例为A类基金份额累计净值（计提业绩报酬之前）与之前各业绩报酬计提日单位累计净值（包括原浙商汇金1号集合资产管理计划存续期限内）的最高值及1.10元两者中高者的差额部分的20%。

上述A类基金份额业绩报酬由基金管理人向基金托管人发送A类基金份额业绩报酬划付指令，由基金托管人于5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（2）B类基金份额业绩报酬

1）B类基金份额业绩报酬提取原则

①按每笔申购B类基金份额（或红利再投份额）分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

②业绩报酬计提基准日为基金分红除息日（若有）、B类基金份额赎回申请日和本基金最后运作日；业绩报酬计提日为基金分红确认日、B类基金份额赎回确认日或本基金最后运作日；

- ③基金分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金，分红日提取业绩报酬的频率原则上每年不超过1次；
- ④基金份额持有人申请赎回时，基金管理人按“先进先出”原则，对份额申购（申购B类份额/红利再投B类份额）的先后次序进行确认赎回份额，计算、提取赎回份额对应业绩报酬。
- 2）B类基金份额业绩报酬的计提方法
- 基金管理人根据期间年化收益率对B类基金份额收益超过6%以上部分按照20%的比例收取基金管理人业绩报酬。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	127,148.50	144,094.54

注：本基金对基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金托管人自身托管的其他基金部分所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.2%年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费，E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有的本基金托管人托管的其他基金部分对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	2,006,007.10	2,006,007.10
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	2,006,007.10	2,006,007.10
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.63%	4.41%

注：上表列示的报告期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，列示的报告期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金在本报告期末及上年度末，未发生除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业	10,974,167.02	20,458.79	21,619,113.06	25,834.99

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司进行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间内，未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2026年06月30日，本基金未持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金。于2025年12月31日，本基金持有1,000,000.00份浙商汇金短债债券A，占其总份额的比例为0.24%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年01月01日 至2025年06月30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	472.99	1,521.59
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	157.71	507.14

注：1、当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

2、根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎

回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

根据相关法律法规和基金合同的要求以及基金的实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券，无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金在本报告期末，未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险和其他价格风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照全面风险管理的要求，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

本基金管理人目前的组织架构体系主要有五个层次：一是董事会及专门委员会的风险管理战略性安排，以及审计委员会的监督检查；二是经理层、经理层下设业务委员会的风险管理决策；三是风险管理部门的风控制衡；四是业务部门及业务立项委员会、产品设计委员会的直接管理；五是合规风控专员在业务部门内部的风控制衡。各风险管理层级按照公司《全面风险管理办法》要求在各自职责范围内履行风险管理职责。业务部门、风险管理部、审计稽核部门共同构成了风险管理三道防线，实施事前、事中与事后的风险防范、监控与评价工作。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除6.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。
本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资 金	10,974,167.02	-	-	-	-	-	10,974,167.02
结算备	44,700.36	-	-	-	-	-	44,700.36

付金							
存出保证金	35,815.45	-	-	-	-	-	35,815.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	114,880,599.28	114,880,599.28
应收清算款	-	-	-	-	-	321,584.26	321,584.26
资产总计	11,054,682.83	-	-	-	-	115,202,183.54	126,256,866.37
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	199,444.96	199,444.96
应付赎回款	-	-	-	-	-	541,208.11	541,208.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,367.26	75,367.26
应付托管费	-	-	-	-	-	20,522.70	20,522.70
应交税费	-	-	-	-	-	482,988.84	482,988.84
其他负债	-	-	-	-	-	89,109.73	89,109.73
负债总计	-	-	-	-	-	1,408,641.60	1,408,641.60
利率敏感度缺口	11,054,682.83	-	-	-	-	113,793,541.94	124,848,224.77
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	15,523,565.58	-	-	-	-	-	15,523,565.58
结算备付金	407,088.22	-	-	-	-	-	407,088.22
存出保证金	117,009.95	-	-	-	-	-	117,009.95
交易性	-	-	-	-	-	115,911,648.28	115,911,648.28

金融资产							
应收清算款	-	-	-	-	-	3,490,288.03	3,490,288.03
应收股利	-	-	-	-	-	38,651.68	38,651.68
资产总计	16,047,663.75	-	-	-	-	119,440,587.99	135,488,251.74
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	101,215.34	101,215.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,501.75	82,501.75
应付托管费	-	-	-	-	-	22,850.65	22,850.65
应交税费	-	-	-	-	-	152,904.06	152,904.06
其他负债	-	-	-	-	-	172,641.44	172,641.44
负债总计	-	-	-	-	-	532,113.24	532,113.24
利率敏感度缺口	16,047,663.75	-	-	-	-	118,908,474.75	134,956,138.50

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末本基金未持有债券，利率变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他市场价格风险,主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金的其他市场价格风险,主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响,由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	4,270,176.00	3.16
交易性金融资产—基金投资	114,880,599.28	92.02	111,641,472.28	82.72
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	114,880,599.28	92.02	115,911,648.28	85.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。
	3、Beta系数是根据组合在报表日股票和基金持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1、沪深300指数上涨5%	4,425,003.91	2,819,461.59
	2、沪深300指数下跌5%	-4,425,003.91	-2,819,461.59

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	置信区间为95%		
	观察期为180天		
分析	风险价值	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	风险价值	-1,958,280.48	-976,543.14
	合计	-1,958,280.48	-976,543.14

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

常见的各层次金融工具举例如下，第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	114,880,599.28	115,911,648.28
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	114,880,599.28	115,911,648.28

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融资产和负债。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至于本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	114,880,599.28	90.99
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,018,867.38	8.73
8	其他各项资产	357,399.71	0.28
9	合计	126,256,866.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票投资组合。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688615	合合信息	681,858.65	0.51
2	300394	天孚通信	677,677.00	0.50

注：1、表中买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、表中“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688615	合合信息	2,261,054.78	1.68
2	688072	拓荆科技	1,318,259.55	0.98
3	300476	胜宏科技	1,037,457.00	0.77
4	600989	宝丰能源	912,336.00	0.68
5	300394	天孚通信	762,969.00	0.57

注：1、表中卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,359,535.65
卖出股票收入（成交）总额	6,292,076.33

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、表中“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的80%，其中投资于股票、股票型基金（包括股票指数基金）、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）的资产占基金资产的比例为20%-80%；货币市场基金投资占基金资产的比例不得超过15%；本基金所持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金在合理控制风险的前提下，通过优选基金投资组合，力求基金资产的长期稳健增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，所投资的子基金整体运作情况良好。本基金的投资符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序	基金代	基金名称	运作方	持有份额	公允价值	占基	是否属
---	-----	------	-----	------	------	----	-----

号	码		式	（份）	（元）	金资 产净 值比 例(%)	于基金 管理人 及管理 人关联 方所管 理的基 金
1	006593	博道中证500增强A	契约型 开放式	4,015,398. 93	11,359,56 3.57	9.10	否
2	100038	富国沪深300指数增强A/B	契约型 开放式	4,934,269. 49	10,297,82 0.43	8.25	否
3	003957	安信量化沪深300增强A	契约型 开放式	3,445,251. 22	7,647,424. 13	6.13	否
4	006729	万家中证500指数增强发起式A	契约型 开放式	3,794,644. 48	7,632,168. 44	6.11	否
5	003949	兴全稳泰债券A	契约型 开放式	4,820,529. 12	5,951,907. 30	4.77	否
6	270044	广发双债添利债券A	契约型 开放式	4,438,342. 65	5,359,298. 75	4.29	否
7	004194	招商中证1000指数增强A	契约型 开放式	1,948,978. 99	4,678,134. 27	3.75	否
8	014233	博时专精特新主题混合C	契约型 开放式	2,416,997. 43	4,198,082. 84	3.36	否
9	519782	交银裕隆纯债债券A	契约型 开放式	2,740,529. 76	3,942,800. 17	3.16	否
10	006502	财通集成电路产业股票A	契约型 开放式	390,000.00	3,879,135. 00	3.11	否
11	512480	半导体	交易型 开放式	1,248,900. 00	3,752,944. 50	3.01	否
12	512800	银行ETF	交易型 开放式	5,071,000. 00	3,722,114. 00	2.98	否
13	202108	南方润元纯债	契约型	2,779,048.	3,655,282.	2.93	否

		债券A/B	开放式	31	24		
14	588200	科创芯片	交易型 开放式	697,100.00	3,440,885.60	2.76	否
15	007616	富国投资级信用债债券型A	契约型 开放式	2,801,258.95	3,049,170.37	2.44	否
16	100032	富国中证红利指数增强A/B	契约型 开放式	3,000,000.41	2,682,000.37	2.15	否
17	008009	华商高端装备制造股票A	契约型 开放式	344,933.00	2,319,950.37	1.86	否
18	588030	科创指基	交易型 开放式	1,000,000.00	2,237,000.00	1.79	否
19	006793	交银稳鑫短债债券A	契约型 开放式	2,000,000.00	2,183,200.00	1.75	否
20	159667	工业母机	交易型 开放式	2,311,800.00	2,112,985.20	1.69	否
21	019919	招商中证2000指数增强C	契约型 开放式	1,000,000.00	2,050,900.00	1.64	否
22	014191	广发先进制造股票发起式A	契约型 开放式	618,535.04	1,957,848.96	1.57	否
23	009707	工银新兴制造混合A	契约型 开放式	265,020.07	1,696,154.95	1.36	否
24	516800	智能制造	交易型 开放式	1,311,800.00	1,673,856.80	1.34	否
25	159796	电池	交易型 开放式	1,405,700.00	1,473,173.60	1.18	否
26	516120	化工50	交易型 开放式	1,464,200.00	1,377,812.20	1.10	否
27	159551	机器人业	交易型 开放式	891,700.00	1,326,849.60	1.06	否
28	562960	绿色电力	交易型 开放式	1,170,000.00	1,312,740.00	1.05	否
29	588010	科创材料	交易型 开放式	782,500.00	1,175,315.00	0.94	否

30	159326	电网设备	交易型 开放式	508,200.00	1,061,121.60	0.85	否
31	159996	家电ETF	交易型 开放式	634,100.00	923,249.60	0.74	否
32	560280	工程机械	交易型 开放式	500,000.00	759,500.00	0.61	否
33	515220	煤炭ETF	交易型 开放式	650,700.00	694,296.90	0.56	否
34	515250	智能汽车	交易型 开放式	549,000.00	592,920.00	0.47	否
35	290008	泰信发展主题 混合	契约型 开放式	258,261.63	560,427.74	0.45	否
36	159565	汽零ETF	交易型 开放式	387,000.00	557,280.00	0.45	否
37	159558	半导体E	交易型 开放式	119,600.00	555,542.00	0.44	否
38	588700	科创生物	交易型 开放式	531,100.00	518,353.60	0.42	否
39	159748	AH创新药	交易型 开放式	709,000.00	511,189.00	0.41	否
40	511990	华宝添益	交易型 开放式	2.00	199.98	0.00	否
41	100025	富国天时货币 A	契约型 开放式	0.20	0.20	0.00	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体本期收到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金及目标基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.13.2 本基金及目标基金投资的前十名证券中，没有超出基金合同约定的备选证券库之外的证券。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,815.45
2	应收清算款	321,584.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	357,399.71

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总	持有份额	占总份

	数 (户)			份额 比例		额比例
浙商 汇金 卓越 配置 一年 持有 混合 (FO F)A	240	148,478.01	2,798,301.12	7.85%	32,836,420.23	92.15%
浙商 汇金 卓越 配置 一年 持有 混合 (FO F)B	933	19,991.81	388,898.61	2.09%	18,263,458.00	97.92%
合计	1,173	46,280.54	3,187,199.73	5.87%	51,099,878.23	94.13%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（--2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	100.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	-	-

	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	43,281.42	0.232%
	合计	43,281.42	0.0797%

注：对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	0
	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	0
	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B	0
	合计	0

注：本报告期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）A	浙商汇金卓越配置一年持有混合（FOF）B
基金合同生效日(2021年11月08日)基金份额总额	71,495,014.17	-
本报告期期初基金份额总额	41,839,117.76	23,329,540.01
本报告期基金总申购份额	-	16,985.53

减：本报告期基金总赎回份额	6,204,396.41	4,694,168.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,634,721.35	18,652,356.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金及目标基金均无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人及高级管理人员未受到调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	2,478,103.00	32.39%	1,080.24	32.39%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

浙商 证券	1	5,173,508.98	67.61%	2,255.13	67.61%	-
中信 证券	1	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-

注：a)截至报告期末，本公司已在深圳交易所、上海交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。本报告期内，本基金深交所退租湘财证券席位。

b)本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

- c)基金交易单元的选择程序如下：
- 1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
 - 2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	21,963,386.56	17.48%
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	103,686,603. 59	82.52%
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本报告期内，本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）增聘基金经理公告	中国证监会规定媒介	2026-01-28
3	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（2026年第1次重大事项临时更新）	中国证监会规定媒介	2026-01-29
4	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-01-29
5	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）减聘基金经理公告	中国证监会规定媒介	2026-02-07
6	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（2026年第2次重大事项临时更新）	中国证监会规定媒介	2026-02-11
7	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）	中国证监会规定媒介	2026-02-11

	基金产品资料概要更新		
8	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A类份额开放日常赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2026-02-28
9	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
10	浙江浙商证券资产管理有限公司关于在直销柜台开展基金认购、申购和转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-02
11	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-15
12	浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）A类份额开放日常赎回业务公告	中国证监会规定媒介	2026-06-05
13	浙江浙商证券资产管理有限公司关于旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定媒介	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内未出现其他影响投资者决策的重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会关于准予浙商汇金1号集合资产管理计划变更注册的批复；
《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
《浙商汇金卓越配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人住所、托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查询；亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.stocke.com.cn。

浙江浙商证券资产管理有限公司
二〇二六年八月二十九日